

『宝船』長期SPAN 収益率・売買分析

08/08/19 12:18:59

収益率一覧表

開始日	終了日	ポートフォリオ名	システム名	証拠金比率	委託手数料
2007/1/1	2007/12/31	traffic03	traffic03	20%	0円(往復)

銘柄名	取引スパン	今月	直近3ヶ月	直近6ヶ月	月間平均	3ヶ月平均	6ヶ月平均	07年	年収益率	標準偏差	シャープレシオ
		-4.26%	7.80%	134.90%	22.07%	74.59%	160.85%	264.81%	264.81%	84.00%	3.15%
1. 米ドル/円	長期	26.07%	8.02%	142.39%	29.08%	80.15%	187.89%	348.95%	348.95%	146.77%	2.38%
2. カナダドル/円	長期	-55.66%	-21.64%	139.34%	19.79%	95.55%	211.92%	237.51%	237.51%	209.57%	1.13%
3. ユーロ/ドル	長期	16.81%	37.01%	122.97%	17.33%	48.08%	82.74%	207.98%	207.98%	69.91%	2.98%

売買分析一覧表

開始日	終了日	ポートフォリオ名	システム名	証拠金比率	委託手数料
2007/1/1	2007/12/31	traffic03	traffic03	20%	0円(往復)

銘柄名	取引スパン	今月	前日比	現建玉	値洗い	経過日数	前月	前々月	最大月間収益	最大月間損失
		-4.26%	-992.00%		0円	0日	36.29%	-24.23%	58.01%	-24.23%
		買取引	益回数	買勝率	売取引	益回数	売勝率			
		13回	9回	69.23%	12回	7回	58.33%			
1. 米ドル/円	長期	今月	前日比	現建玉	値洗い	経過日数	前月	前々月	最大月間収益	最大月間損失
		26.07%	0.00%		0円	0日	76.39%	-94.44%	76.39%	-94.44%
		買取引	益回数	買勝率	売取引	益回数	売勝率			
		5回	4回	80.00%	4回	3回	75.00%			
2. カナダドル/円	長期	今月	前日比	現建玉	値洗い	経過日数	前月	前々月	最大月間収益	最大月間損失
		-55.66%	-4793.00%	買い	-1.14円	12日	32.47%	1.55%	107.64%	-90.25%
		買取引	益回数	買勝率	売取引	益回数	売勝率			
		5回	2回	40.00%	5回	2回	40.00%			
3. ユーロ/ドル	長期	今月	前日比	現建玉	値洗い	経過日数	前月	前々月	最大月間収益	最大月間損失
		16.81%	1817.00%	売り	0.0124円	19日	0.00%	20.20%	48.81%	-11.66%
		買取引	益回数	買勝率	売取引	益回数	売勝率			
		3回	3回	100.00%	3回	2回	66.67%			

「シャープレシオとは」 シャープレジオとは、リスクに対してどれだけのリターンを得られるかを示す指標であり、シャープレジオが大きいほどリスクに比して大きなリターンを実現していることを示します。逆に、超過収益を上げるために、どれだけリスクをとっているかを表しているといえます。分子が超過収益を示し、分母がリスクの大きさを示します。

「ボリンジャーバンドとは」 ボリンジャーバンドとは、市場動向のテクニカル分析を行うためのチャートの一つで、統計学上の標準偏差をチャートにプロットするものです。通常、第一標準偏差、第二標準偏差を上下に取り、移動平均性をプロットします。結果、第一標準偏差及び第二標準偏差の上値と下値が2本ずつ+移動平均線と5本の線で構成されます。第一標準偏差の範囲内に終値が収まる確率は68%、第二標準偏差の範囲内に終値が収まる確率は、95%とされ、バンドの広さや移動平均線と補助線の位置関係で売買のタイミングを図ります。

『宝船』長期SPAN 純資産推移

株式会社トラフィック

ポートフォリオ名 : traffic03

開始日 20070101 - 終了日 20071231

証拠金比率 : 20.0 %

初期投資資金 : 600000
 最終純資産 : 2188889
 年単利収益率 : 264.81 %
 月単利収益率 : 22.07 %
 最大月間利益 : 58.01 %
 最大月間損失 : -24.23 %
 勝月率 : 83.33 %
 シャープレシオ : 3.15

NO.	ポートフォリオ名	システム名	今月	前日比	現建玉	値洗い	経過日数	前月	前々月
0.	traffic03	traffic03	-4.26 %	-9.92		0 円	0 日	36.29 %	-24.23 %
1.	米ドル/円	長期	26.07 %	0.00		0 円	0 日	76.39 %	-94.44 %
2.	カナダドル/円	長期	-55.66 %	-47.93	買い	-1.14 円	12 日	32.47 %	1.55 %
3.	ユーロ/米ドル	長期	16.81 %	18.17	売り	0.0124 円	19 日	0.00 %	20.20 %



『宝船』長期SPAN サマリー 08/08/19

System ポートフォリオサマリー

開始日	終了日	ポートフォリオ	銘柄名	システム数
2007/1/17	2007/12/31	traffic03	米ドル/円・カナダドル/円・ユーロ/ドル	3回

テスト日数	348 日
トータル月数	12ヶ月
再投資処理(複利運用)	0ヶ月毎
テストパラメータ	
初期投資資金	600,000
帳尻損益金	1,528,230
最高純資産	2,386,944
支払手数料合計	0
年単利利益率	252.97%
最大月間利益	58.01%
勝月率	75.00%
MARレシオ	4.17
シャープレシオ	2.92
スターリングレシオ	0.00
買い取引	11 回
利益	8 回
損失	3 回
勝率	72.73%
買い利益合計	1,268,112
最大利益	427,094
1回平均	158,514
買い損失合計	-204,478
最大損失	-102,039
1回平均	-68,159
リスク・リワード・レシオ	3.04
買い利益取引期間平均	41.1 日
最大取引期間	87 日
最小取引期間	4 日
買い損失取引期間平均	19.7 日
最大取引期間	22 日
最小取引期間	18 日
年度別取引回数(2007)	22 回

営業日数	248 日
委託手数料	0円
証拠金比率	20.00%
最終純資産	2,117,793
現建玉値洗い	-10,438
最低純資産	515,205
平均証拠金使用率	15.38%
月単利利益率	21.08%
最大月間損失	-24.23%
年標準偏差	86.68%
リワード/リスク インデックス	94.74%
プロフィット/ロス インデックス	81.65%
売り取引	11 回
利益	6 回
損失	5 回
勝率	54.55%
売り利益合計	614,023
最大利益	251,595
1回平均	102,337
売り損失合計	-149,427
最大損失	-59,799
1回平均	-29,885
売り利益取引期間平均	45.0 日
最大取引期間	65 日
最小取引期間	29 日
売り損失取引期間平均	23.6 日
最大取引期間	52 日
最小取引期間	1 日
年度別取引勝率(2007)	63.64%

月間利益率

開始日	終了日	ポートフォリオ	証拠金比率	手数料	再投資(複利運用)
2007/1/17	2007/12/31	traffic03	20.00%	0円	0ヶ月毎

年/月	純資産	月間損益	利益率/初期投資金	手数料	消費税
2007/01	587,579	-12,421	-2.07%	0	0
2007/02	594,910	7,330	1.22%	0	0
2007/03	735,286	140,377	23.40%	0	0
2007/04	1,000,965	265,679	44.28%	0	0
2007/05	1,264,989	264,024	44.00%	0	0
2007/06	1,308,396	43,407	7.23%	0	0
2007/07	1,487,600	179,203	29.87%	0	0
2007/08	1,722,969	235,369	39.23%	0	0
2007/09	2,071,010	348,041	58.01%	0	0
2007/10	1,925,627	-145,383	-24.23%	0	0
2007/11	2,143,341	217,714	36.29%	0	0
2007/12	2,117,793	-25,548	-4.26%	0	0

～ご使用にあたっての注意事項～

- ※相場に適したリスクマネジメントを行わず、高いレバレッジによって取引を行った場合、大きな利益と同様に大きな損失を被る可能性があります。
- ※本ソフトウェア『宝船』は必ずしも資産の増加を保証するものではありません。掲載しております実績などは、『宝船』のシステム理論によるバックテスト結果であり、実際の取引記録ではありません。
- ※自動売買機能のご利用はお客様の任意によるものです。完全な勝率をお約束するものではありません。
- ※ご購入のお申し込みの際は、本ソフトウェアの使用許諾の同意が必要です。

